

## Ⅱ. 流動性カバレッジ比率に関する定量的開示事項

### 1. 連結流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2022年9月期		2022年6月期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,632,812		3,076,589	
<b>資金流出額 (2)</b>		<b>資金流出率を乗じる前の額</b>	<b>資金流出率を乗じた後の額</b>	<b>資金流出率を乗じる前の額</b>	<b>資金流出率を乗じた後の額</b>
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	5,500,522	456,835	5,445,584	453,907
3	うち、安定預金の額	1,338,495	40,154	1,302,025	39,060
4	うち、準安定預金の額	4,162,027	416,680	4,143,559	414,846
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,138,826	867,552	2,352,266	1,043,225
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	—	—	—	—
7	うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	2,086,782	815,507	2,287,991	978,950
8	うち、負債性有価証券の額	52,044	52,044	64,274	64,274
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		15,218		17,792
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	135,678	38,564	141,184	40,556
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	24,564	24,564	26,143	26,143
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	—	—	—	—
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	111,114	14,000	115,041	14,413
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	37,756	31,830	35,220	31,244
15	偶発事象に係る資金流出額	1,273,951	34,712	1,270,081	33,381
16	資金流出合計額		1,444,714		1,620,108
<b>資金流入額 (3)</b>		<b>資金流入率を乗じる前の額</b>	<b>資金流入率を乗じた後の額</b>	<b>資金流入率を乗じる前の額</b>	<b>資金流入率を乗じた後の額</b>
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	—	—	—	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	269,424	145,944	249,287	130,529
19	その他資金流入額	42,852	19,845	61,061	28,132
20	資金流入合計額	312,276	165,789	310,348	158,662
<b>連結流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,632,812		3,076,589
22	純資金流出額		1,278,924		1,461,445
23	連結流動性カバレッジ比率		205.8%		210.5%
24	平均値計算用データ数		62		61

## 2. 単体流動性カバレッジ比率

(単位：百万円、%、件)

項 目		2022年9月期		2022年6月期	
<b>適格流動資産 (1)</b>					
1	適格流動資産の合計額	2,632,812		3,076,589	
<b>資金流出額 (2)</b>		<b>資金流出率を乗じる前の額</b>	<b>資金流出率を乗じた後の額</b>	<b>資金流出率を乗じる前の額</b>	<b>資金流出率を乗じた後の額</b>
2	リテール無担保資金調達に係る資金流出額	5,500,522	456,835	5,445,584	453,907
3	うち、安定預金の額	1,338,495	40,154	1,302,025	39,060
4	うち、準安定預金の額	4,162,027	416,680	4,143,559	414,846
5	ホールセール無担保資金調達に係る資金流出額	2,150,709	879,434	2,363,447	1,054,406
6	うち、適格オペレーショナル預金の額	—	—	—	—
7	うち、適格オペレーショナル預金及び負債性有価証券以外のホールセール無担保資金調達に係る資金の額	2,096,015	824,741	2,296,390	987,350
8	うち、負債性有価証券の額	54,693	54,693	67,056	67,056
9	有担保資金調達等に係る資金流出額		15,218		17,792
10	デリバティブ取引等、資金調達プログラム及び与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	135,678	38,564	141,184	40,556
11	うち、デリバティブ取引等に係る資金流出額	24,564	24,564	26,143	26,143
12	うち、資金調達プログラムに係る資金流出額	—	—	—	—
13	うち、与信・流動性ファシリティに係る資金流出額	111,114	14,000	115,041	14,413
14	資金提供義務に基づく資金流出額等	14,021	8,095	11,317	7,341
15	偶発事象に係る資金流出額	1,288,725	34,712	1,284,850	33,381
16	資金流出合計額		1,432,861		1,607,386
<b>資金流入額 (3)</b>		<b>資金流入率を乗じる前の額</b>	<b>資金流入率を乗じた後の額</b>	<b>資金流入率を乗じる前の額</b>	<b>資金流入率を乗じた後の額</b>
17	有担保資金運用等に係る資金流入額	—	—	—	—
18	貸付金等の回収に係る資金流入額	282,826	159,346	262,714	143,956
19	その他資金流入額	42,874	19,867	61,082	28,153
20	資金流入合計額	325,700	179,214	323,796	172,110
<b>単体流動性カバレッジ比率 (4)</b>					
21	算入可能適格流動資産の合計額		2,632,812		3,076,589
22	純資金流出額		1,253,646		1,435,276
23	単体流動性カバレッジ比率		210.0%		214.3%
24	平均値計算用データ数		62		61